

国泰货币市场证券投资基金

[2013] 第三季度报告

基金管理人:国泰基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一三年十月二十二日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会对本基金报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性完整性承担责任。

基金托管人和代销机构对本基金报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告书经基金托管人复核。

本报告书于2013年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 国泰货币

基金主代码 020007

交易代码 020007

基金运作方式 契约型开放式

基金合同生效日 2005年6月21日

报告期末基金份额总额 946,743,954.46份

投资目标 在保证本金安全和资产流动性最大的前提下，追求超过业绩比较基准的收益。

投资策略 本基金主要为投资者提供流动性风险管理工具，主要结合短期利率变动，合理安排组合期限和类型比例，在保证本金安全性、流动性的前提下，获得超过基准的收益。根据对宏观经济及资金流向趋势的判断，适时调整组合的期限结构，通过定期申购赎回机制，动态调整组合中货币市场基金、债券基金和其他资产的比例分布，考虑法律法规的规定及相关各类账户的到期收益率、预期收益率以及不同类型资产的流动性指标等来决定基金组合的类型配置，通过定期调整和收益曲线配置来创造债券组合。

业绩比较基准 同同期7天通知存款利率(税后)。

风险收益特征 本基金属于货币市场基金中高流动性的品种，其预期风险和预期收益都低于股票基金、债券基金和混合型基金。

基金管理人 国泰基金管理有限公司

基金托管人 中国农业银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2013年7月1日-2013年9月30日)

1.本期已实现收益 12,003,294.73

2.本期利润 12,003,294.73

3.期末基金资产净值 946,743,954.46

注:本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额；本期利润指本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

注:基金的过往业绩并不代表未来表现。货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益即为本期利润。

注:基金净值分位数按月度计算。

3.2 基金合同当事人及基金净值与业绩比较基准收益率的历史走势对比图(2005年6月21日至2013年9月30日)

注:①基金合同生效日为2005年6月21日，本基金在一个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

②自2009年1月1日起，本基金的业绩比较基准变更为“同同期7天通知存款利率(税后)”。详见2009年12月29日《中国证券报》刊登的《关于国泰货币市场证券投资基金业绩比较基准和修改基金合同的公告》。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名 职务 从任本基金的基金期限 任职日期 离任日期 说明

胡丽娟 基金经理, 固定收益部基金经理, 衍生品投资经理, 衍生品研究员, 固定收益部总监 2011-12-5 -

本基金的基金经理, 固定收益部基金经理, 衍生品投资经理, 衍生品研究员, 固定收益部总监。

本基金的基金经理, 固定收益部基金经理, 衍生品投资经理, 衍生品研究员, 固定收益部总监。